

gretl コンソール: help と入力するとコマンドのリストが表示されます
? **ols** y **const** x d1 d2 d3

モデル 1: 最小二乗法 (OLS), 観測: 1-40
従属変数: y

	係数	標準誤差	t 値	p 値	
const	-7.37345	1.17218	-6.290	3.21e-07	***
x	1.04736	0.0885740	11.82	8.87e-014	***
d1	7.09509	0.858806	8.262	9.74e-010	***
d2	4.18055	0.708883	5.897	1.05e-06	***
d3	2.42534	0.647759	3.744	0.0006	***

Mean dependent var	5.500000	S. D. dependent var	2.908872
Sum squared resid	66.06645	S. E. of regression	1.373904
R-squared	0.799799	Adjusted R-squared	0.776918
F(4, 35)	34.95600	P-value(F)	8.95e-12
Log-likelihood	-66.79317	Akaike criterion	143.5863
Schwarz criterion	152.0307	Hannan-Quinn	146.6396

? ols y const x

モデル 2: 最小二乗法 (OLS), 観測: 1-40

従属変数: y

	係数	標準誤差	t 値	p 値
const	0.809394	1.00504	0.8053	0.4256
x	0.519968	0.103942	5.002	1.32e-05 ***

Mean dependent var	5.500000	S. D. dependent var	2.908872
Sum squared resid	198.9690	S. E. of regression	2.288237
R-squared	0.397064	Adjusted R-squared	0.381197
F(1, 38)	25.02489	P-value (F)	0.000013
Log-likelihood	-88.84293	Akaike criterion	181.6859
Schwarz criterion	185.0636	Hannan-Quinn	182.9072

? **probit** d **const** x d1 d2 d3

モデル 3: プロビット・モデル, 観測: 1-40

従属変数: d

標準誤差はヘッシアン (Hessian) に基づく

	係数	標準誤差	z	限界効果
const	-3.93309	1.27022	-3.096	
x	0.321069	0.0975752	3.290	0.128086
d1	2.14634	0.896135	2.395	0.651827
d2	1.25688	0.732408	1.716	0.451090
d3	0.721100	0.653686	1.103	0.277484

Mean dependent var	0.500000	S. D. dependent var	0.506370
McFadden R-squared	0.227679	Adjusted R-squared	0.047343
Log-likelihood	-21.41327	Akaike criterion	52.82655
Schwarz criterion	61.27094	Hannan-Quinn	55.87977

「正しく予測された」ケース数 = 30 (75.0%)
f(beta' x) (説明変数の平均における) = 0.399
尤度比検定: カイ二乗(4) = 12.6252 [0.0133]

		予測値	
		0	1
実績値	0	15	5
	1	5	15

残差の正規性の検定 -

帰無仮説: 攪乱項は正規分布に従う

検定統計量: カイ二乗(2) = 1.61882

なお、p 値 (p-value) = 0.445121

? probit d const x

モデル 4: プロビット・モデル, 観測: 1-40

従属変数: d

標準誤差はヘッシアン (Hessian) に基づく

	係数	標準誤差	z	限界効果
const	-1.37615	0.622513	-2.211	
x	0.152426	0.0649105	2.348	0.0608092

Mean dependent var	0.500000	S. D. dependent var	0.506370
McFadden R-squared	0.110261	Adjusted R-squared	0.038127
Log-likelihood	-24.66879	Akaike criterion	53.33758
Schwarz criterion	56.71534	Hannan-Quinn	54.55888

「正しく予測された」ケース数 = 23 (57.5%)
f(beta' x) (説明変数の平均における) = 0.399
尤度比検定: カイ二乗(1) = 6.11419 [0.0134]

		予測値	
		0	1
実績値	0	11	9
	1	8	12

残差の正規性の検定 -

帰無仮説: 攪乱項は正規分布に従う

検定統計量: カイ二乗(2) = 7.67326

なお、p 値 (p-value) = 0.0215662

?